

# 東京短資デイリーレポート

2023/12/28

## <12月27日のマネタリーベース>

6,741,000
-----------

## <12月28日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,486,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,449,700
日銀当座預金残高増減前日比	+36,700

## <12月28日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因		-2,700
財政等要因		-3,300
資金過不足		-6,000
金融調節		
CP等買入	-1,500	新規
国債補完供給	+44,700	-46,000
金融調節合計		-2,800
当座預金増減-②		-8,800

## <12月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,440,900
準備預金残高	4,707,600
積み終了先	4,706,000
超過準備	4,706,000
非準備先残高	733,300

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,969,100
今積み期間所要準備額(平均)	128,000
残り要積立額(積数)	14,800
残り要積立額(平均)	800
準備進捗率(%)	99.6
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+57.7

## <12月29日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因		+100
財政等要因		-7,300
資金過不足		-7,200
金融調節確定分		
CP等買入	-2,900	+4,000
国債補完供給	+46,000	
金融調節合計		+47,100
当座預金増減		+39,900

## <12月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆800億円)で 無担保コール0/Nは-0.030%~-0.015% での合いが中心か。
---

## <12月29日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,525,800	+84,900
+40,000	5,520,800	+79,900
+35,000	5,515,800	+74,900
+30,000	5,510,800	+69,900
+25,000	5,505,800	+64,900
+20,000	5,500,800	+59,900
+15,000	5,495,800	+54,900
+10,000	5,490,800	+49,900
+5,000	5,485,800	+44,900
±0	5,480,800	+39,900
-5,000	5,475,800	+34,900
-10,000	5,470,800	+29,900
-15,000	5,465,800	+24,900
-20,000	5,460,800	+19,900
-25,000	5,455,800	+14,900
-30,000	5,450,800	+9,900
-35,000	5,445,800	+4,900
-40,000	5,440,800	-100
-45,000	5,435,800	-5,100

## <12月28日 日銀オペ入札結果> ※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(11:50) 国債補完供給	23/12/28-23/12/29	応札 46,219億 落札 46,219億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/12/28-23/12/29	応札 0億 落札 0億

## <12月28日 各オペ残高と内訳> (カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初末)	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給
103,843	63,652	成長基盤強化支援資金供給	1,001
12/19~1/10	12/26(3-5Y) 4,253.	貸出増加支援資金供給	2/18~2/16 0.
1/6~1/6	12/26(5-10Y) 4,751.	3/4~3/4 2,178.	5/17~5/17 0.
1/5~1/6	12/26(10-25Y) 1,504.	6/3~6/3 1,950.	8/19~8/19 381.
1/10~1/10	12/26(25Y-) 751.	9/2~9/2 1,804.	11/18~11/18 93.
1/13~1/14	12/26(物国) 600.	12/2~12/2 1,712.	2/17~2/17 346.
1/16~1/16	20,009.	3/3~3/3 6,793.	5/12~5/12 181.
1/19~1/20	1,163.	6/2~6/2 2,644.	8/18~8/18 0.
		9/1~9/1 5,024.	11/17~11/17 0.
		12/1~12/1 2,464.	0百万ドル
			12/28~1/11 0.
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			成長基盤強化支援米ドル特別
			16,426百万ドル
			3/3~3/4 2,153.
			6/2~6/3 5,566.
			9/5~9/5 5,382.
			12/4~12/4 3,325.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
			国債短期証券買入額(月初末)
			国債売現先オペ
			2,001
			0
			12/6 1,001.
			12/27 1,000.
			CP買入額(月初末)
			3,985
			12/12 3,985.
			(12/29 3,990.)
			社債買入額(月初末)
			1,000
			12/19 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/4 701.
			ETF買入額(企業支援)
			14,628
			約定 21/3/31 12.
			J-REIT買入額
			6,823
			約定 22/6/14 12.
			※直近約1週間の実施分を記載
			国債補完供給
			46,219
			12/28-12/29 46,219.
			12/28-12/29 0.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/4 701.
			ETF買入額(企業支援)
			14,628
			約定 21/3/31 12.
			J-REIT買入額
			6,823
			約定 22/6/14 12.
			※直近約1週間の実施分を記載
			成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。
			ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。 共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。
			<12月28日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 103,843 CP等買入(推定) 21,800
			共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 60,500
			国債買現先 0
			被災地金融機関支援 1,001
			気候変動対応支援 62,648
			成長基盤支援 30,589 手形売出 0
			貸出増加支援 730,665 国債売現先 0
			供給オペ合計 998,781 国債補完供給 46,219
			貸出(推定) 0 国債売現先(米ドル担保) 0
			供給額合計 998,781 吸収額合計 46,219
			差し引き 952,562

## <12月28日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	1M	3M	1M	3M	3M	6M
0.000			+0.080000		買気配	-0.150
1W 売気配	-0.020		+0.028000		買気配	-0.150
2W 売気配	-0.020		+0.090000		買気配	-0.150
1M 売気配	-0.020					

## <12月27日のJ-レ市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高		増減
	有担保	無担保	
市場合計	205,902	26,739	+931
有担保	26,739		+849
無担保	179,163		+82

## <12月28日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

	無担保コール				有担保コール				東京レポレート	
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	-0.080	0.001	-0.016	-0.003				-----	-0.096	+0.001
トムネ	-0.035	0.001	-0.025	-0.017				-----	-0.129	-0.020
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.030	-0.025	-0.029	-0.039				-----	-0.167	+0.052
2週間物				-----				-----	-0.157	+0.034
3週間物				-----				-----	-0.159	+0.020
1ヶ月物	-0.008	0.001	-0.003	-0.296				-----	-0.157	+0.009
3ヶ月物	0.035	0.040	0.036	+0.010				-----	-0.150	+0.003
6ヶ月物				-----				-----	-0.102	+0.006
1年物				-----				-----	-0.065	+0.002

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。  
本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および確実性を保証するものではありません。  
非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。  
債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。  
商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会